

嘉实超短债证券投资基金 2007年第三季度报告

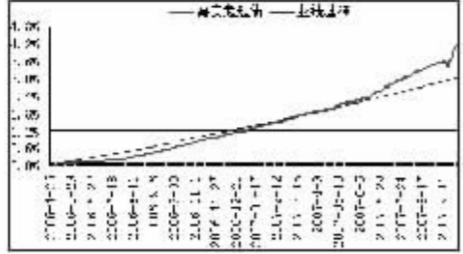


图:嘉实超短债基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

§1 重要提示 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

§2 基金产品概况 1. 基金名称 嘉实超短债(深交所净值显示简称:嘉实超短) 2. 基金代码 070009(深交所净值显示代码:160709)

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:元 序号 主要财务指标 2007年7月1日至2007年9月30日

Table with 5 columns: 序号, 主要财务指标, 2007年7月1日至2007年9月30日, 2007年7月1日至2007年6月30日, 2007年6月30日

§4 基金经理报告 4.1 基金经理情况介绍 郭林军先生,数量经济学硕士,5年证券从业经历。曾就职于中信证券金融产品开发小组从事债券研究。

§5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 投资组合报告 基金资产组合 金额(元) 占基金总资产的比例

Table with 3 columns: 投资组合, 金额(元), 占基金总资产的比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 按行业分类的股票投资组合 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金总资产比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占基金总资产比例

§6 开放式基金份额变动 项目 期末余额(元) 报告期初基金份额总额 4,842,592.143.08

§7 备查文件目录 1. 中国证监会批准嘉实超短债证券投资基金募集的文件; 2. 嘉实超短债证券投资基金基金合同;

§8 其他资产的构成 项目 期末余额(元) 交易保证金 4,979,473.61

§9 投资组合报告附注 9. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

§10 基金管理人 嘉实基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

§11 基金托管人 中国银行股份有限公司

§12 基金投资顾问 嘉实基金管理有限公司

4.1 行情回顾及运作分析 报告期内,宏观经济形势是“三过”,即贸易顺差过大、信贷投放过多、投资增长过快,再加上较快的物价增长速度,央行采取了适度从紧的货币政策,两次提高存款准备金率、三次发行定向票据、三次提高存贷款利率。

4.2 本基金业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.0070元,本报告期基金份额净值增长率为1.64%,同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.3 市场展望和投资策略 尽管CPI在四季度可能冲高回落,但“三过”问题仍然存在,9月底的货币政策委员会会议提出了加大货币政策调控力度,展望2008年,CPI可能再度走高,债券市场仍然面临较大压力。

4.4 基金管理人 吴洪坚先生,清华大学工学硕士,4年固定收益证券投资经历。曾任职于中国银行交易中心(上海),从事人民币固定收益投资及交易等工作。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 投资组合报告 基金资产组合 金额(元) 占基金总资产的比例

Table with 3 columns: 投资组合, 金额(元), 占基金总资产的比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 按行业分类的股票投资组合 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金总资产比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占基金总资产比例

§6 开放式基金份额变动 项目 期末余额(元) 报告期初基金份额总额 4,842,592.143.08

§7 备查文件目录 1. 中国证监会批准嘉实成长收益证券投资基金设立的文件; 2. 嘉实成长收益证券投资基金基金合同;

§8 其他资产的构成 项目 期末余额(元) 交易保证金 4,979,473.61

§9 投资组合报告附注 9. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

§10 基金管理人 嘉实基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

§11 基金托管人 中国银行股份有限公司

§12 基金投资顾问 嘉实基金管理有限公司

嘉实成长收益证券投资基金 2007年第三季度报告

2007年11月5日至2007年9月30日

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。报告期内,本基金的各项投资比例符合基金合同第十八条(二)投资范围和(六)投资组合比例限制的规定。

0 投资于股票、债券、货币及其他基金资产的比例不低于基金资产总值的80%; 0 持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%; b) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司的股票,不得超过该证券的10%; 4) 投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;

§4 管理人报告 4.1 基金经理情况介绍 刘天君先生,管理学硕士,5年证券从业经历。曾任平安保险(集团)公司投资管理中心研究员,嘉实基金管理有限公司交易员、研究员。

4.2 报告期末基金资产组合情况 投资组合报告 基金资产组合 金额(元) 占基金总资产的比例

Table with 3 columns: 投资组合, 金额(元), 占基金总资产的比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 按行业分类的股票投资组合 行业 股票市值(元) 市值占基金总资产比例

Table with 3 columns: 行业, 股票市值(元), 市值占基金总资产比例

5.3 报告期末按市值占基金总资产净值比例大小排序的前十名股票明细 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金总资产比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占基金总资产比例

§6 开放式基金份额变动 项目 期末余额(元) 报告期初基金份额总额 2,934,559.44

§7 备查文件目录 1. 中国证监会批准嘉实成长收益证券投资基金设立的文件; 2. 嘉实成长收益证券投资基金基金合同;

§8 其他资产的构成 项目 期末余额(元) 交易保证金 4,979,473.61

嘉实超短债证券投资基金 2007年第三季度报告

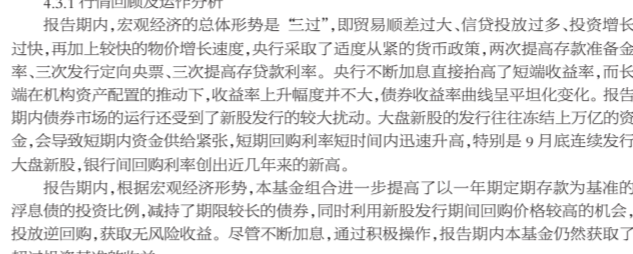


图:嘉实超短债基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.1 行情回顾及运作分析 报告期内,宏观经济形势是“三过”,即贸易顺差过大、信贷投放过多、投资增长过快,再加上较快的物价增长速度,央行采取了适度从紧的货币政策,两次提高存款准备金率、三次发行定向票据、三次提高存贷款利率。

4.2 本基金业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.0070元,本报告期基金份额净值增长率为1.64%,同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.3 市场展望和投资策略 尽管CPI在四季度可能冲高回落,但“三过”问题仍然存在,9月底的货币政策委员会会议提出了加大货币政策调控力度,展望2008年,CPI可能再度走高,债券市场仍然面临较大压力。

4.4 基金管理人 吴洪坚先生,清华大学工学硕士,4年固定收益证券投资经历。曾任职于中国银行交易中心(上海),从事人民币固定收益投资及交易等工作。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 投资组合报告 基金资产组合 金额(元) 占基金总资产的比例

Table with 3 columns: 投资组合, 金额(元), 占基金总资产的比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 按行业分类的股票投资组合 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金总资产比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占基金总资产比例

§6 开放式基金份额变动 项目 期末余额(元) 报告期初基金份额总额 4,842,592.143.08

§7 备查文件目录 1. 中国证监会批准嘉实超短债证券投资基金募集的文件; 2. 嘉实超短债证券投资基金基金合同;

§8 其他资产的构成 项目 期末余额(元) 交易保证金 4,979,473.61

§9 投资组合报告附注 9. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

§10 基金管理人 嘉实基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

§11 基金托管人 中国银行股份有限公司

§12 基金投资顾问 嘉实基金管理有限公司

嘉实超短债证券投资基金 2007年第三季度报告

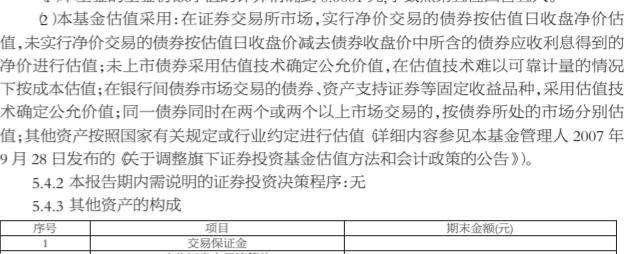


图:嘉实超短债基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.1 行情回顾及运作分析 报告期内,宏观经济形势是“三过”,即贸易顺差过大、信贷投放过多、投资增长过快,再加上较快的物价增长速度,央行采取了适度从紧的货币政策,两次提高存款准备金率、三次发行定向票据、三次提高存贷款利率。

4.2 本基金业绩表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.0070元,本报告期基金份额净值增长率为1.64%,同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.3 市场展望和投资策略 尽管CPI在四季度可能冲高回落,但“三过”问题仍然存在,9月底的货币政策委员会会议提出了加大货币政策调控力度,展望2008年,CPI可能再度走高,债券市场仍然面临较大压力。

4.4 基金管理人 吴洪坚先生,清华大学工学硕士,4年固定收益证券投资经历。曾任职于中国银行交易中心(上海),从事人民币固定收益投资及交易等工作。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 投资组合报告 基金资产组合 金额(元) 占基金总资产的比例

Table with 3 columns: 投资组合, 金额(元), 占基金总资产的比例

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 按行业分类的股票投资组合 序号 股票代码 股票名称 数量(股) 期末市值(元) 市值占基金总资产比例

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占基金总资产比例

§6 开放式基金份额变动 项目 期末余额(元) 报告期初基金份额总额 4,842,592.143.08

§7 备查文件目录 1. 中国证监会批准嘉实超短债证券投资基金募集的文件; 2. 嘉实超短债证券投资基金基金合同;

§8 其他资产的构成 项目 期末余额(元) 交易保证金 4,979,473.61

§9 投资组合报告附注 9. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

§10 基金管理人 嘉实基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

§11 基金托管人 中国银行股份有限公司

§12 基金投资顾问 嘉实基金管理有限公司